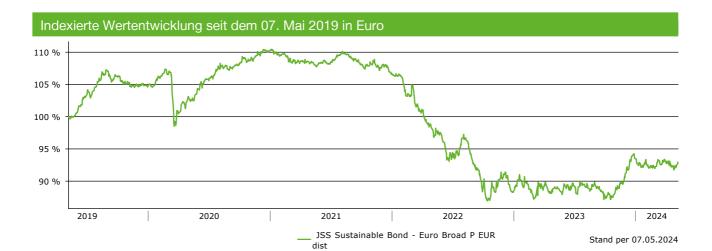
Stand: 07.05.2024





## Anlageziel

Der Fonds investiert in erstklassige, auf Euro lautende Anleihen, deren Emittenten einen Beitrag zu einer nachhaltigen Wirtschaftsweise leisten. Diese Länder zeichnen sich durch eine möglichst geringe und effiziente Nutzung von Umweltund Sozialressourcen aus. Organisationen integrieren Nachhaltigkeit bei der Mittelverwendung und messen den Erfolg auch unter nachhaltigen Gesichtspunkten. Unternehmen zeichnen sich durch ein umweltgerechtes, öko-effizientes Management aus.

# Fondsdetails

Fondskategorie: Anleihenfonds
WKN: 113590
ISIN: LU0158938935
Kapitalanlagegesellschaft: Manag. (Lux.) S.A.
Sitz der KAG: Luxemburg

Sitz der KAG: Luxemburg
Nähere fundmanagementInformationen: lu.jsafrasarasin.com
Depotbank: CACEIS Investor

Services Bank S.A.

(Lux)
Fondswährung: EUR
Auflagedatum: 06.01.

Auflagedatum: 06.01.2003 Ende Geschäftsjahr: 30.06. Ertragsverwendung: Ausschüttend

## Aktuelle Daten

Fondsvolumen

(07.05.2024): 46,91 Mio. EUR Kurs per 07.05.2024: 108,33 €

# Rollierende 12-Monats Wertentwicklung



Stand per 07.05.2024

# Wertentwicklung

Zeitraum	laufendes Jahr	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre
Fonds	-0,60 %	4,60 %	-14,23 %	-7,02 %	2,68 %
Zeitraum	3 Jahre p.a	5 Jahre p.a	10 Jahre p.a	seit Auflage p.a	seit Auflage
Fonds	-4,99 %	-1,44 %	0,26 %	1,84 %	47,43 %

Stand per 07.05.2024

## WICHTIGER HINWEIS ZU DEN WERTENTWICKLUNGEN

Die o.a. Darstellungen der Wertentwicklung (Performance) beziehen sich ausschließlich auf eine Direktanlage in den/die zugrundeliegenden Investmentfonds. Rückschlüsse auf die Wertentwicklung und Ablaufleistung eines diese/diesen Fonds beinhaltenden Versicherungsproduktes lassen sich daraus nicht ableiten. Das Veranlagungsrisiko trägt der Versicherungsnehmer. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf die zukünftige Entwicklung eines Investmentfonds zu. Historische Wertentwicklungen sind keine Garantie für eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft und somit **unverbindlich**. Zukünftige Wertentwicklungen sind nicht prognostizierbar. Die Berechnung der Wertentwicklung erfolgt gemäß BVI-Methode.

Quelle für alle Fondsdaten auf diesen Seiten: cleversoft GmbH

Stand: 07.05.2024



### Fondskonditionen

Einstiegskosten Merkur Lebensversi-

0 %

für Neuverträge, sonst tarifabhängig

Einstiegskosten

cherung:

gemäß Prospekt:

3,00 %

nein

Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder

Betriebskosten1: 0,70 % (05.06.2023)

Erfolgsgebühren und Carried Interests2:

Transaktionskosten3: 0,00 %

#### Kennzahlen

Volatilität (10 Jahre): 4,14 %

Sharpe Ratio (10 Jahre) (akt. risikoloser Zins 3,88 %):

0,01

Max. Verlust (10 Jahre): -21,28 %

#### Fußnoten

- Unter "Verwaltungsgehühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten" versteht man eine Pro-zentzahl bezogen auf das Gesamtvolumen eines In-vestmentfonds, welche die jährlich wiederkehrenden Kosten angibt. Darunter fallen die Verwaltungs-gebühr und alle Gebühren, die im letzten Geschäftsjahr erhoben wurden.
- <sup>2</sup> Manche Fonds erheben Erfolgsgebühren und Carried Interests. Das sind leistungsbezogene Vergütungen, deren Ausgestaltung im Verkaufsprospekt beschrieben wird. Der Rechenschaftsbericht des Fonds für jedes Geschäftsjahr enthält Einzelheiten zu den konkret berechneten Kosten.
- <sup>3</sup> Hierbei handelt es sich um eine Schätzung der Kosten, die pro Jahr anfallen, wenn der Fonds die zu-grundeliegenden Anlagen für das Produkt kauft oder verkauft. Der tatsächliche Betrag hängt davon ab, wie viel die Fondsgesellschaft kauft und verkauft.

Die drei o.g. Kostenarten können von Jahr zu Jahr voneinander abweichen und werden im jeweils aktu-ellen Basisinformationsblatt eines Fonds veröffentlicht. Die aktuell geltenden Kosten und Gebühren sind daher dem Basisinformationsblatt zu entnehmen. Der Rechenschaftsbericht des Fonds für jedes Geschäftsjahr enthält weitere Einzelheiten zu den genauen berechneten Kosten und Gebühren. Das aktuell gültige Verkaufsprospekt, das Basisinformati-onsblatt und der Rechenschaftsbericht liegen bei der Kapitalanlagegesellschaft und bei der Merkur Le-bensversicherung auf und werden Ihnen auf Anfrage kostenlos von der Merkur Lebensversicherung zur Verfügung gestellt. Die auf diesem Factsheet zu den o.g. drei Kostenarten ausgewiesenen Kosten sind in der Wertentwicklung des Fonds bereits beinhaltet und werden Ihnen nicht gesondert in Rechnung gestellt.

## Portfoliostruktur (31.01.2024)

## Aufteilung nach Laufzeiten

3 - 5 Jahre	19,50 %
7 - 10 Jahre	18,83 %
< 1 Jahr	15,34 %
> 15 Jahre	14,69 %
5 - 7 Jahre	13,43 %

#### Größte Positionen

3.25% Niederlande 1/2044	3,52 %
0.5% Niederlande 1/2040	3,22 %
3.25% Spanien 4/2034	2,71 %
KFW 1.375%/22-070632	2,47 %
Nordrhein-Westfalen 11/2029	2,34 %
EU 6/2028	1,93 %
4.25% Hellenic Republic Government 6/2033	1,79 %
0.875% CPPIB Capital 2/2029	1,61 %
FRANKREICH 23/250649/3	1,60 %
1% Cassa Depositi 2020/11.02.2030	1,40 %

Die vorliegenden Bestandsdaten basieren auf letztverfügbaren Informationsquellen und können daher von den Bestandsdaten der Fondsbuchhaltung (juristischer Bestand) abweichen.

## Risikoindikator laut Fondsgesellschaft

höheres Risiko geringeres Risiko ← potentiell geringerer Ertrag potentiell höherer Ertrag -> 3 4 5 2 6 1

Basisinformationsblatt vom 08.04.2024

# Risiko - Rendite - Diagramm (07.05.2024)



## Rechtliche Hinweise

Die Angaben auf diesen Seiten stellen weder ein Verkaufsangebot noch eine angebotsgleiche Werbung noch eine Aufforderung zum Kauf des Fonds dar. Die Merkur Lebensversicherung und die cleversoft GmbH übernehmen keine Haftung für die Richtigkeit und Aktualität der dargestellten Daten und Informationen. Alle veröffentlichten Angaben stellen keine Anlageberatung oder sonstige Empfehlung dar, sondern geben lediglich eine zusammenfassende Kurzdarstellung wesentlicher Merkmale des Fonds.

Alleinige Grundlage für den Kauf von Wertpapieren sind nur die aktuellen Verkaufsunterlagen (Basisinformationsblatt, Verkaufsprospekt, Jahresbericht und der Halbjahresbericht) zu den jeweiligen Investmentfonds. Die Verkaufsunterlagen sind kostenfrei bei der jeweiligen Verwaltungsgesellschaft sowie bei der Merkur Lebensversicherung erhältlich.

Quelle für alle Fondsdaten auf diesen Seiten: cleversoft GmbH



# **ESG-Informationen**

Stand: 07.05.2024

Gegenstand dieses Dokuments sind Nachhaltigkeitsinformationen zu diesem Finanzprodukt. Es handelt sich um Werbematerial. Für Informationen über die berücksichtigten Umweltziele lesen Sie bitte aufmerksam die Nachhaltigkeitsinformationen des Herstellers.

# JSS Sustainable Bond - Euro Broad P EUR dist

ISIN / WKN	LU0158938935 / 113590
Emittent / Hersteller	J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A.
Benchmark	ICE BofA Euro Broad Market Index
	Artikel 9
EU-Offenlegungskategorisierung*	Einstufung nach Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR)
PAI Berücksichtigung**	Ja, für folgende Kriterien: Treibhausgas-Emissionen; Abfälle; Soziale und Arbeitnehmerbelange
Verkaufsprospekt	https://merkur-leben- at.factsheetslive.com/docrepository/Prospectus/LU0158938935/de_DE/
SFDR vorvertragliche Informationen***	https://merkur-leben- at.esg4insurance.tools.factsheetslive.com/produkt/LU0158938935/SfdrPreContractual/de_ XX/
SFDR regelmäßige Informationen***	https://merkur-leben- at.esg4insurance.tools.factsheetslive.com/produkt/LU0158938935/SfdrPeriodicDisclosure/ de_XX/
SFDR Website Informationen***	https://merkur-leben- at.esg4insurance.tools.factsheetslive.com/produkt/LU0158938935/SfdrWebDisclosure/de_ XX/
ESG-Fokus	-
Aktualisierung durch Hersteller	15.02.2024

<sup>\*</sup> Artikel 6: Finanzprodukte, die weder ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, noch nachhaltige Investitionen anstreben; Artikel 8: Finanzprodukte, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, und die Unternehmen, in die investiert wird, wenden Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung an; Artikel 9: Finanzprodukte, die nachhaltige Investitionen anstreben.

Mindestanteil von nachhaltigen Anlagen nach SFDR



<sup>\*\*</sup> PAI (Principle Adverse Impact) sind die negativen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren.

<sup>\*\*\*</sup> SFDR - Sustainable Finance Disclosure Regulation (Offenlegungsverordnung)



# **ESG-Informationen**

Stand: 07.05.2024

## **Anlagestrategie**

Anlageziel Die angestrebten nachhaltigen Investitionen des JSS Sustainable Bond – Euro Broad (der "Fonds") orientieren sich an Art. 9 der SFDR, dem Übereinkommen von Paris und der dazugehörigen Klimaschutzverpflichtung von J. Safra Sarasin, bis 2035 CO2-Neutralität in den Portfolios zu erreichen. Der Fonds wird sich an den folgenden konkreten Nachhaltigkeitszielen orientieren, die sich aus definierten Zielvorgaben und messbaren Kennzahlen zur Überprüfung der Fortschritte zusammensetzen: 1. Ziel: Klimaschutz. Zielvorgabe: 1.1. Klimaneutralität bei Unternehmensanleihen bis 2035 (Klimaschutzverpflichtung). 1.2. Mindestanteil "grüner Anlagen", d. h. Anleihen, deren Erlöse definitionsgemäß für umweltfreundliche Maßnahmen verwendet werden. 2. Ziel: Stärkung des gesellschaftlichen Zusammenhalts. Zielvorgabe: 2.1. Finanzierung "sozialer Anlagen", d. h. Anleihen, deren Erlöse definitionsgemäß für soziale Maßnahmen verwendet werden. 2.2. Finanzierung "nachhaltiger Investitionen", d. h. Anleihen, deren Erlöse definitionsgemäß für Nachhaltigkeitsmaßnahmen verwendet werden. Kennzahlen: Das Nettovermögen des Fonds wird wie folgt investiert: a) mindestens 30% in Anlagen mit Umwelt-, Sozial- oder Nachhaltigkeitslabel oder in nachhaltigkeitsbezogene Anleihen, b) mindestens 10% in Anlagen mit Umweltlabel, c) mindestens 10% in Anlagen mit Sozial- oder mit Nachhaltigkeitslabel entsprechend den Marktstandards. Neben den wirkungsorientierten Zielen integriert der Fonds umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte (ESG) in den Anlageprozess, wobei er das Ziel verfolgt, umstrittene Engagements zu verringern, das Portfolio an internationalen Normen auszurichten, die Nachhaltigkeitsrisiken zu mindern und die aus ESG-Trends erwachsenden Chancen zu nutzen sowie eine fundiertere Übersicht der Portfolio-Positionen zu erhalten. Der Fonds schließt Emittenten, die in umstrittene Aktivitäten verwickelt sind, wie in den "standardmäßigen Ausschlüssen von JSS" aufgeführt und in Kapitel 3.1 des Verkaufsprospekts des Fonds beschrieben, systematisch aus. Mehr als 90% der Vermögenswerte des Teilfonds müssen über ein ESG-Rating von JSS verfügen. Anschließend kommt ein Best-in-Class- bzw. positives ESG-Auswahlverfahren zur Anwendung, um ein Anlageuniversum festzulegen, das sich auf die nach ESG-Kriterien stärker abschneidenden Emittenten beschränkt. Es wird davon ausgegangen, dass durch dieses Verfahren das Anlageuniversum – das sich aus sämtlichen Emittenten zusammensetzt, für die Daten zur Verfügung stehen – um mindestens 20% reduziert wird.Der Fonds ist bestrebt, unter Einhaltung der im Abschnitt "Anlagepolitik" des Verkaufsprospekts angegebenen Qualitätskriterien und bei ausgewogener Risikostreuung regelmäßige Erträge zu erzielen. Anlagepolitik Der Fonds wird aktiv verwaltet und bildet keine Benchmark nach. Der Fonds wird jedoch unter Bezugnahme auf den ICE BofA Euro Broad Market Index (die "Benchmark") verwaltet Das Vermögen des Fonds wird weltweit ausschließlich in auf Euro lautende Anleihen, Wandelanleihen und Anleihen mit Optionsscheinen investiert. Der Fonds investiert in Schuldtitel, die von Ländern, Organisationen oder Unternehmen ausgegeben werden, die einen aktiven Beitrag zu einer nachhaltigen Wirtschaftsweise leisten. Einzelne Emittenten können aufgrund kritischer Aktivitäten (z. B. Kernenergie- oder Waffenproduktion) ausgeschlossen werden. Bis zu 10% des Fondsvermögens können in bedingte Wandelanleihen (CoCos) investiert werden. Der in Wandelanleihen und Anleihen mit Optionsscheinen angelegte Teil des Vermögens wird insgesamt auf höchstens 25% des Teilfondsvermögens beschränkt. In der Regel handelt es sich bei den meisten Fondspositionen um Benchmarkkomponenten. Um konkrete Anlagegelegenheiten zu nutzen, kann der Anlageverwalter nach eigenem Ermessen Wertpapiere auswählen, die nicht in der Benchmark enthalten sind. Darüber hinaus berücksichtigt der Anlageverwalter Nachhaltigkeitskriterien, sodass bestimmte Benchmarkkomponenten vom Anlageuniversum ausgeschlossen werden. Die Positionen und ihre Gewichtungen im Portfolio des Teilfonds werden sich von den Gewichtungen der Benchmarkkomponenten unterscheiden. Daher können die Renditen des Teilfonds von der Benchmark-Performance abweichen. Aktienklassenrichtlinie: Diese Aktienklasse des Fonds schüttet die Erträge grundsätzlich im Oktober an die Anleger aus (vorausgesetzt, dass der Fonds Erträge erwirtschaftet hat und die Voraussetzungen des Verkaufsprospekts erfüllt sind). Abwicklung von Zeichnungs- und Rücknahmeaufträgen Sie können Aktien dieses Fonds an jedem Geschäftstag zurückgeben oder umtauschen.

## Das FNG-Siegel für nachhaltige Investmentfonds

Das **FNG-Siegel** ist der Qualitätsstandard nachhaltiger Geldanlagen auf dem deutschsprachigen Markt. Die ganzheitliche Methodik des Gütezeichens basiert auf einem Mindeststandard. Dazu zählen Transparenzkriterien und die Berücksichtigung von Arbeits- & Menschenrechten, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. Auch müssen alle Unternehmen des jeweiligen Fonds komplett auf Nachhaltigkeits-Kriterien hin analysiert werden und das Produkt eine explizite Nachhaltigkeits-Strategie vorweisen. Tabu sind Investitionen in Atomkraft, Kohlebergbau, relevante Kohleverstromung, Fracking, Ölsande, Tabak, sowie Waffen & Rüstung. Hochwertige Nachhaltigkeits-Fonds, die sich in den Bereichen "institutionelle Glaubwürdigkeit", "Produktstandards" und "Portfolio-Fokus" (Titelauswahl, Engagement und KPIs) besonders hervorheben, erhalten bis zu drei Sterne. Die externe und unabhängige Nachhaltigkeits-Zertifizierung muss jährlich erneuert werden. Prüfer des FNG-Siegels ist die Research Group on Sustainable Finance der Universität Hamburg. Den Prüfprozess begleitet außerdem ein unabhängiges Komitee mit interdisziplinärer Expertise. <u>Informationen zum FNG-Siegel</u>



## **Rechtliche Informationen**

Die offengelegten ESG-Informationen werden der cleversoft GmbH von der genannten Kapitalanlagegesellschaft (Hersteller) zur Verfügung gestellt. Die ESG-Informationen werden mit größtmöglicher Sorgfalt erstellt, regelmäßig geprüft und aktualisiert. Trotz aller Sorgfalt können sich die Informationen inzwischen verändert haben oder auf fehlerhaften Daten Dritter basieren. Die Versicherungsgesellschaft und cleversoft GmbH können keine Gewähr für die Richtigkeit, Vollständigkeit und Aktualität der ausgewiesenen Daten übernehmen. Die in dem ESG-Dokument publizierten Informationen stellen keine Empfehlung, Angebot oder Aufforderung zur Investition in einen Fonds dar.